

融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金

2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通新机遇灵活配置混合
基金主代码	002049
前端交易代码	002049
后端交易代码	002050
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 17 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,010,360,400.94 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，投资于优质上市公司，并结合积极的大类资产配置，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	在经济周期各阶段，综合对所跟踪的宏观经济指标和市场指标的分析，本基金对大类资产进行配置的策略为：在经济的复苏和繁荣期超配股票资产；在经济的衰退和政策刺激阶段，超配债券等固定收益类资产，力争通过资产配置获得部分超额收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价（总值）指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市

	场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。
--	------------------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	田青
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 67595096
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	(010) 67595096
传真		(0755) 26935005	(010) 66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年 11 月 17 日 (基金合同生效日) - 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	45,754,579.10	28,856,131.24	52,480.82
本期利润	58,068,131.19	9,510,546.50	7,721,588.38
加权平均基金份额本期利润	0.0502	0.0056	0.0033
本期基金份额净值增长率	5.17%	0.70%	-0.60%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0168	0.0014	-0.0092
期末基金资产净值	1,031,905,236.85	1,261,124,044.24	2,709,329,115.04
期末基金份额净值	1.021	1.001	0.994

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

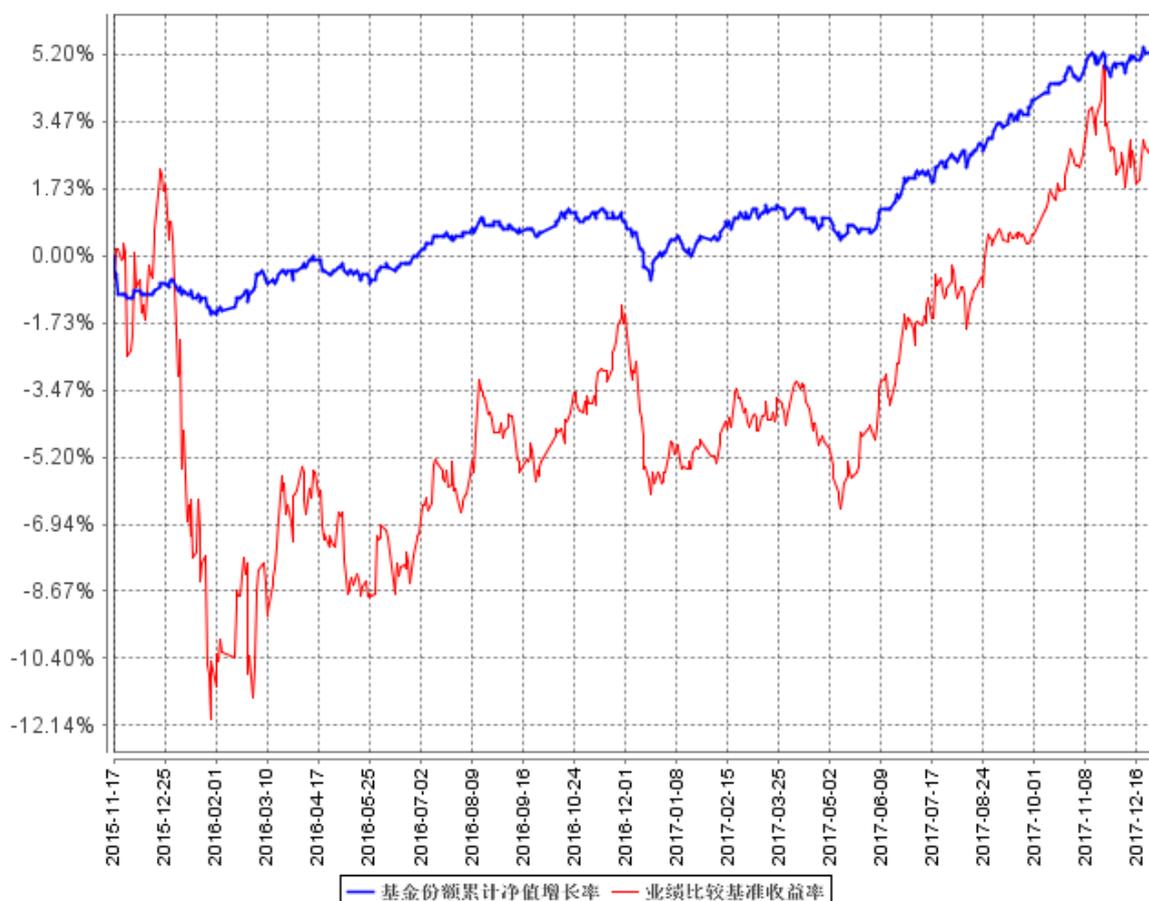
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.19%	0.12%	1.96%	0.40%	-0.77%	-0.28%
过去六个月	3.20%	0.12%	4.25%	0.35%	-1.05%	-0.23%
过去一年	5.17%	0.11%	8.60%	0.32%	-3.43%	-0.21%
自基金合同生效起至今	5.27%	0.11%	2.54%	0.57%	2.73%	-0.46%

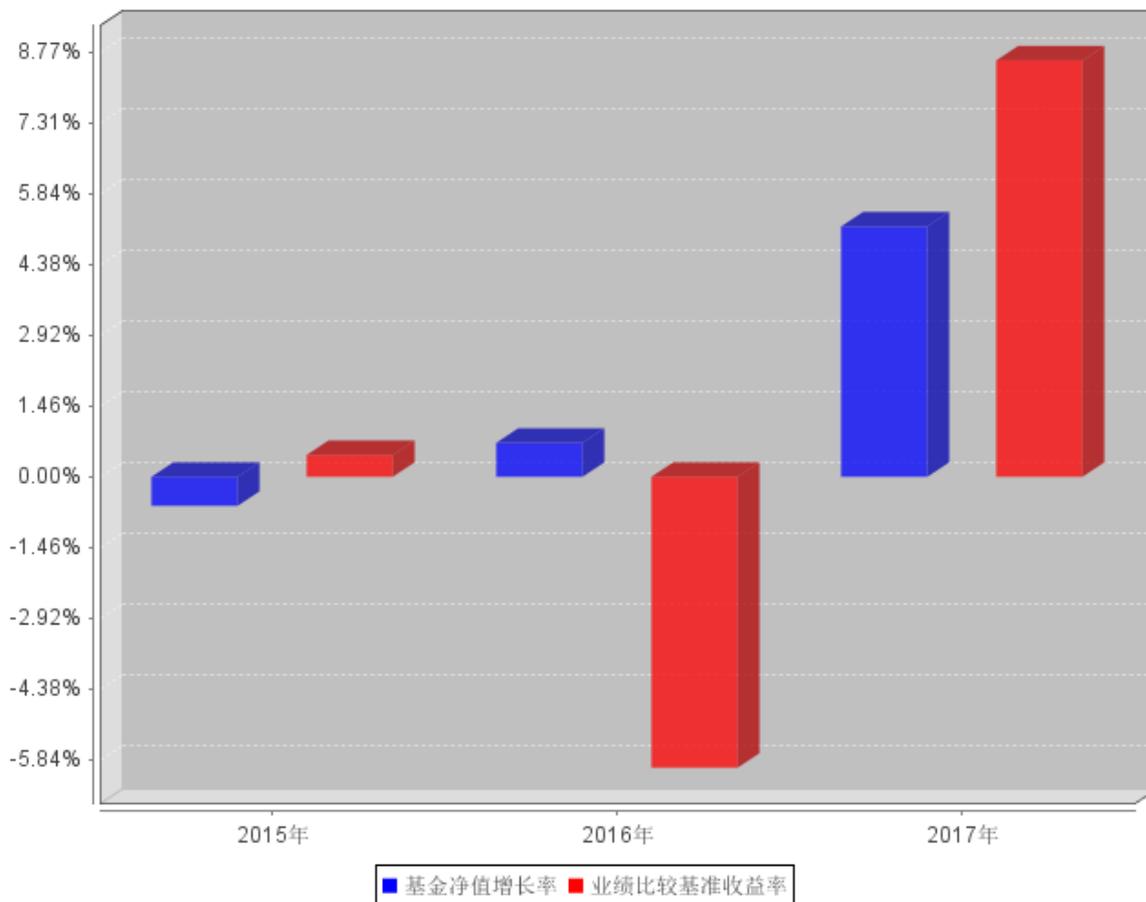
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2015 年 11 月 17 日，合同生效当年按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额 分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发放 总额	年度利润分配合计	备注
2017	0.3100	35,840,668.29	5.31	35,840,673.60	
2016	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
合计	0.3100	35,840,668.29	5.31	35,840,673.60	

注：本基金合同生效日为 2015 年 11 月 17 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8 号文批准，于 2001 年 5 月 22 日成立，公司注册资本 12500 万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：新时

代证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司（Nikko AssetManagement Co., Ltd.）40%。

截至 2017 年 12 月 31 日，公司共管理六十五只开放式基金：即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证 100 指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮 100 指数基金（LOF）、融通易支付货币基金、融通动力先锋混合基金、融通领先成长混合基金（LOF）、融通内需驱动混合基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健混合基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法（QDII-FOF）基金、融通汇财宝货币市场基金、融通可转债债券基金、融通通泰保本混合基金、融通通福债券基金（LOF）、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利基金、融通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区域新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通中证大农业指数基金（LOF）、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通成长 30 混合基金、融通中国风 1 号混合基金、融通通盈保本混合基金、融通增利债券基金、融通增裕债券基金、融通增鑫债券基金、融通增益债券基金、融通增祥债券基金、融通新消费混合基金、融通增丰债券基金、融通通安债券基金、融通通优债券基金、融通通乾研究精选混合基金、融通新趋势混合基金、融通国企改革新机遇混合基金、融通通尚混合基金、融通通裕债券基金、融通通和债券基金、融通沪港深智慧生活混合基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券基金、融通稳利债券基金、融通通宸债券基金、融通通玺债券基金、融通通穗债券基金、融通通润债券基金、融通通颐定期开放债券基金、融通人工智能指数基金（LOF）、融通新动力灵活配置混合、融通收益增强债券基金和融通中国概念债券基金（QDII）。其中，融通债券基金、融通深证 100 指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张一格	本基金的基金经理、固定收益投资总监	2016 年 9 月 22 日	-	11	张一格先生，中国人民银行研究生部经济学硕士、南开大学法学学士，美国特许金融分析师（CFA）。11 年证券投资从业经历，具有基金从业资格，现任融通基金管理有限公司固定收益投资总监。历任兴业银行资金营运中心投资经理、国泰基金管理有限公司国泰民安增利债券等基金的基金经理。2015 年 6 月加入融通基金管理有限公司，现任融通

					易支付货币、融通通盈保本、融通增裕债券、融通增祥债券、融通增丰债券、融通通瑞债券、融通通优债券、融通月月添利定期开放债券、融通通鑫灵活配置混合、融通新机遇灵活配置混合、融通通裕债券、融通收益增强债券基金的基金经理。
余志勇	本基金的基金经理、研究部总监	2015年11月17日	-	17	余志勇先生, 武汉大学金融学硕士、工商管理学学士, 17 年证券投资从业经历, 具有证券从业资格, 现任融通基金管理有限公司研究部总监。历任湖北省农业厅研究员、闽发证券公司研究员、招商证券股份有限公司研究发展中心研究员。2007 年 4 月加入融通基金管理有限公司, 历任研究部行业研究员、行业组长, 现任融通通泰保本、融通通鑫灵活配置混合、融通新机遇灵活配置混合、融通增裕债券、融通增丰债券、融通通尚灵活配置混合、融通四季添利债券 (LOF)、融通通润债券、融通新动力灵活配置混合基金的基金经理。

注：任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了保证旗下的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人制定了《融通基金管理有限公司公平交易制度》，公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制

度、流程和技术手段来保证公平交易原则的实现。同时，本基金管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

考虑到本基金设计的目的是获得绝对收益和保持基金净值增长率的平稳性，本基金在报告期开始阶段一直保持较低的股票仓位，在积极进行新股申购的基础上，将富余的资金主要配置在高流动性债券和回购类资产。

上半年本基金认为经济看平，但市场预期波动较大，因此股票选择以低价股为主，对成长股相对谨慎，较好地规避了上半年成长股的回调风险，但在消费股白马龙头方面配置力度不够。

本基金从二季度开始选择借助公司整体研究力量和相对均衡的投资策略，力求在行业配置和个股选择上，获取持续稳定的超额收益 α ，从而保持了基金净值的平稳上升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.021 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.17%，业绩比较基准收益率为 8.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计 2018 年宏观经济谨慎乐观：供给侧改革为传统产业转型和化解潜在的金融风险赢得时间；新消费和新基建逐步夯实经济新周期的基础；高端制造业逐步推进中国产业结构升级。另外国际经济整体复苏也为中国经济的转型营造相对友好的环境。

我们预计资本市场会继续保持慢牛的走势，主要是在经济表现非常强的韧性下，一些新的增长点会逐步显现，加上资本市场流动性趋好和机构化特征日益明显，基本面研究投资会继续成为市场主流。

具体板块看，我们看好盈利驱动的行业，上半年看好周期股价值化的投资机会，例如钢铁、

煤炭；下半年看好先进制造、5G、半导体、物联网等新兴行业；全年看好大金融和消费普及的投资机会。

本基金将会继续采取相对均衡的组合投资策略，力求在行业配置和个股选择上，获取持续稳定的超额收益 α 。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方估值服务机构的估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员不包含本基金基金经理。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及应用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。本基金基金经理不参与估值决定，参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突。

截至本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议，由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 本基金于 2017 年 4 月 6 日实施 2017 年第 1 次利润分配，以 2017 年 3 月 24 日的可分配收益为基准，每 10 份基金份额派发红利 0.1 元。

(2) 本基金于 2017 年 6 月 27 日实施 2017 年第 2 次利润分配，以 2017 年 6 月 21 日的可分配收益为基准，每 10 份基金份额派发红利 0.05 元。

(3) 本基金于 2017 年 10 月 10 日实施 2017 年第 3 次利润分配，以 2017 年 9 月 25 日的可分配收益为基准，每 10 份基金份额派发红利 0.16 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产

净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，基金实施利润分配的金额为 35,840,673.60 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

本基金 2017 年年度财务会计报告已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告（普华永道中天审字(2018)第 22354 号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	107,486,737.18	940,920.17
结算备付金	105,663.78	2,207,159.59
存出保证金	21,770.87	61,394.86
交易性金融资产	803,441,875.46	1,304,442,137.33
其中：股票投资	97,383,702.64	124,531,488.33
基金投资	-	-
债券投资	706,058,172.82	1,179,910,649.00

资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	189,940,604.91	-
应收证券清算款	500,985.75	143,498.44
应收利息	11,463,387.64	16,121,567.94
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,112,961,025.59	1,323,916,678.33
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017年12月31日	2016年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	80,000,000.00	61,000,000.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	9.87
应付管理人报酬	524,842.66	1,282,477.41
应付托管费	174,947.55	213,746.22
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	121,001.65	184,871.34
应交税费	-	-
应付利息	134,996.88	1,529.25
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	100,000.00	110,000.00
负债合计	81,055,788.74	62,792,634.09
所有者权益：		
实收基金	1,010,360,400.94	1,259,376,337.99
未分配利润	21,544,835.91	1,747,706.25
所有者权益合计	1,031,905,236.85	1,261,124,044.24
负债和所有者权益总计	1,112,961,025.59	1,323,916,678.33

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.021 元，基金份额总额 1,010,360,400.94 份。

7.2 利润表

会计主体：融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	73,644,607.73	36,650,395.17
1. 利息收入	40,292,303.20	42,186,825.34
其中：存款利息收入	189,013.77	4,607,348.01
债券利息收入	37,484,052.02	36,172,534.70
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,619,237.41	1,406,942.63
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	21,029,883.66	10,793,198.55
其中：股票投资收益	21,008,889.14	13,179,292.75
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,516,808.14	-2,897,741.17
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,537,802.66	511,646.97
3. 公允价值变动收益	12,313,552.09	-19,345,584.74
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	8,868.78	3,015,956.02
减：二、费用	15,576,476.54	27,139,848.67
1. 管理人报酬	11,012,655.24	21,618,259.43
2. 托管费	2,340,856.32	3,603,043.26
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,086,708.65	1,150,059.26
5. 利息支出	527,218.60	173,025.72
其中：卖出回购金融资产支出	527,218.60	173,025.72
6. 其他费用	609,037.73	595,461.00
三、利润总额	58,068,131.19	9,510,546.50
减：所得税费用	-	-
四、净利润	58,068,131.19	9,510,546.50

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	1,259,376,337.99	1,747,706.25	1,261,124,044.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	58,068,131.19	58,068,131.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-249,015,937.05	-2,430,327.93	-251,446,264.98
其中：1. 基金申购款	165,863.93	2,147.52	168,011.45
2. 基金赎回款	-249,181,800.98	-2,432,475.45	-251,614,276.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-35,840,673.60	-35,840,673.60
五、期末所有者权益（基金净值）	1,010,360,400.94	21,544,835.91	1,031,905,236.85
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,726,875,633.97	-17,546,518.93	2,709,329,115.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,510,546.50	9,510,546.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,467,499,295.98	9,783,678.68	-1,457,715,617.30
其中：1. 基金申购款	3,926.09	-1.10	3,924.99
2. 基金赎回款	-1,467,503,222.07	9,783,679.78	-1,457,719,542.29
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,259,376,337.99	1,747,706.25	1,261,124,044.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 张帆 _____

基金管理人负责人

_____ 颜锡廉 _____

主管会计工作负责人

_____ 刘美丽 _____

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，本基金自2017年12月21日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更使本基金2017年12月31日的基金资产净值及2017年度净损益减少，相关影响非重大。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司(“融通基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
新时代证券股份有限公司(“新时代证券”)	基金管理人的股东
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市融通资本管理股份有限公司	基金管理人的子公司
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.3.1 关联方报酬

7.4.3.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	11,012,655.24	21,618,259.43
其中：支付销售机构的客户维护费	34.74	0.45

注：1、自 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 25 日，支付基金管理人融通基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

根据基金份额持有人大会于 2016 年 2 月 26 日表决通过的《关于融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》，自 2016 年 2 月 26 日至 2017 年 7 月 11 日，支付基金管理人融通基金的管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.20% / 当年天数。

根据基金份额持有人大会于 2017 年 7 月 11 日表决通过的《关于融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金降低管理费率有关事项的议案》，自 2017 年 7 月 12 日起，支付基金管理人融通基金的管理人报酬按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.60% / 当年天数。

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.3.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,340,856.32	3,603,043.26

注：自 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 2 月 25 日，支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

根据基金份额持有人大会于 2016 年 2 月 26 日表决通过的《关于融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》，自 2016 年 2 月 26 日起，支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其

计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

7.4.3.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.3.3 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.3.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.3.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,486,737.18	85,128.79	940,920.17	443,195.05

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.3.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.3.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.4 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002892	科力尔	2017-8-17	2018-8-16	新股锁定	17.56	32.16	11,000	193,160.00	353,760.00	-
002860	星帅尔	2017-4-12	2018-4-11	新股锁定	19.81	39.79	7,980	158,083.80	317,524.20	-
603161	科华	2017-12-28	2018-1-5	新股未	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-

	控股			上市						
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-1-3	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

注：1. 基金可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

2. 本基金于 2017 年 3 月 31 日网下申购新股星帅尔成功，确认数量 7,980 股，确认单价为 19.81 元，根据发行公告，本基金持有的股份锁定期为 12 个月，锁定期自该股票在深交所上市交易之日起开始计算。

3. 本基金于 2017 年 8 月 10 日网下申购新股科力尔成功，确认数量 11,000 股，确认单价为 17.56 元，根据发行公告，本基金持有的股份锁定期为 12 个月，锁定期自该股票在上交所上市交易之日起开始计算。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601003	柳钢股份	2017 年 10 月 17 日	重大资产重组	7.98	2018-1-18	7.50	93,300	680,926.00	744,534.00	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 80,000,000.00 元，于 2018 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例
----	----	----	-----------

			(%)
1	权益投资	97,383,702.64	8.75
	其中：股票	97,383,702.64	8.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	706,058,172.82	63.44
	其中：债券	706,058,172.82	63.44
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	189,940,604.91	17.07
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	107,592,400.96	9.67
8	其他各项资产	11,986,144.26	1.08
9	合计	1,112,961,025.59	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,927,705.00	0.57
C	制造业	58,806,842.41	5.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,010,203.00	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	1,257,839.94	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,312,082.75	0.13
J	金融业	12,434,421.66	1.20
K	房地产业	3,183,565.20	0.31
L	租赁和商务服务业	5,828,665.48	0.56
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	556,482.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,049,752.00	0.39
S	综合	-	-
	合计	97,383,702.64	9.44

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601888	中国国旅	134,332	5,828,665.48	0.56
2	600887	伊利股份	180,600	5,813,514.00	0.56
3	600276	恒瑞医药	73,100	5,042,438.00	0.49
4	600801	华新水泥	321,900	4,548,447.00	0.44
5	600176	中国巨石	273,100	4,448,799.00	0.43
6	601318	中国平安	58,000	4,058,840.00	0.39
7	600031	三一重工	419,400	3,803,958.00	0.37
8	600036	招商银行	110,983	3,220,726.66	0.31
9	600622	光大嘉宝	177,160	3,183,565.20	0.31
10	002343	慈文传媒	78,000	2,777,580.00	0.27

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人融通基金管理有限公司网站(<http://www.rtfund.com>)的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600031	三一重工	11,325,894.24	0.90
2	603609	禾丰牧业	10,781,997.00	0.85
3	600054	黄山旅游	8,139,560.00	0.65
4	000001	平安银行	6,731,534.00	0.53
5	601888	中国国旅	5,916,284.18	0.47
6	600528	中铁工业	5,878,945.13	0.47
7	600887	伊利股份	5,621,469.00	0.45
8	600036	招商银行	5,598,251.15	0.44
9	600276	恒瑞医药	5,023,794.40	0.40
10	601318	中国平安	4,632,356.00	0.37
11	603588	高能环境	4,498,539.30	0.36
12	002548	金新农	4,429,682.20	0.35
13	600138	中青旅	4,318,952.00	0.34
14	600809	山西汾酒	4,111,122.60	0.33
15	002343	慈文传媒	3,875,420.00	0.31
16	600808	马钢股份	3,815,734.00	0.30
17	600801	华新水泥	3,654,094.78	0.29
18	000568	泸州老窖	3,619,204.00	0.29

19	601933	永辉超市	3,601,152.00	0.29
20	000651	格力电器	3,593,571.00	0.28

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002008	大族激光	15,322,143.00	1.21
2	600068	葛洲坝	11,432,977.00	0.91
3	600919	江苏银行	10,094,357.00	0.80
4	603609	禾丰牧业	9,721,462.25	0.77
5	601997	贵阳银行	8,754,688.00	0.69
6	600031	三一重工	8,738,181.50	0.69
7	600054	黄山旅游	8,581,664.96	0.68
8	000709	河钢股份	8,144,825.00	0.65
9	600691	阳煤化工	7,878,244.00	0.62
10	000001	平安银行	7,351,879.00	0.58
11	002570	贝因美	7,119,971.20	0.56
12	600115	东方航空	6,854,891.21	0.54
13	603588	高能环境	6,358,509.51	0.50
14	300059	东方财富	5,968,566.00	0.47
15	600528	中铁工业	5,799,206.00	0.46
16	600426	华鲁恒升	5,707,557.20	0.45
17	300284	苏交科	5,509,247.52	0.44
18	600022	山东钢铁	5,480,000.00	0.43
19	600809	山西汾酒	4,836,469.70	0.38
20	000568	泸州老窖	4,679,080.00	0.37

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	314,858,149.78
卖出股票收入（成交）总额	379,973,214.90

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	68,583,000.00	6.65
	其中：政策性金融债	68,583,000.00	6.65
4	企业债券	139,037,276.00	13.47
5	企业短期融资券	20,058,000.00	1.94
6	中期票据	240,314,800.00	23.29
7	可转债（可交换债）	1,527,096.82	0.15
8	同业存单	236,538,000.00	22.92
9	其他	-	-
10	合计	706,058,172.82	68.42

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	101652003	16 南电 MTN001	800,000	78,656,000.00	7.62
2	150409	15 农发 09	500,000	49,915,000.00	4.84
3	111770673	17 邯郸银行 CD111	500,000	49,770,000.00	4.82
4	111714262	17 江苏银行 CD262	500,000	48,815,000.00	4.73
5	136768	16 苏海 01	500,000	45,570,000.00	4.42

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券中报告期内无发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	21,770.87
2	应收证券清算款	500,985.75
3	应收股利	-
4	应收利息	11,463,387.64
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,986,144.26

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132007	16 凤凰 EB	890,890.00	0.09

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

236	4,281,188.14	1,010,231,515.15	99.99%	128,885.79	0.01%
-----	--------------	------------------	--------	------------	-------

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	22,780.37	0.0023%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年11月17日）基金份额总额	200,063,961.00
本报告期期初基金份额总额	1,259,376,337.99
本报告期基金总申购份额	165,863.93
减：本报告期基金总赎回份额	249,181,800.98
本报告期末基金份额总额	1,010,360,400.94

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

自本基金管理人以通讯方式组织召开了基金份额持有人大会，会议投票时间自 2017 年 6 月 16 日起至 2017 年 7 月 10 日 17:00 止。2017 年 7 月 11 日大会表决通过了《关于融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金降低管理费率有关事项的议案》（以下简称“本次会议议案”）。基金管理人于表决通过之日起 5 日内报中国证监会备案。根据本次会议议案，基金管理人对《融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金托管协议》进行修改，并据此修订了《融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》。本基金管理人根据基金份额持有人大会决议执行基金管理费率及托管费率的调整事项，将管理费率由 1.2% 调整为 0.6%，正式实施日为 2017 年 7 月 11 日。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大变动

2017 年 3 月 4 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第五届董事会第十七次临时会议审议并通过，同意孟朝霞女士辞去公司总经理职务，并决定由公司董事长高峰先生代为履行公司总经理职务。

2017 年 6 月 3 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经本基金管理人第五届董事会第十八次临时会议决议审议并通过，决定由张帆先生担任公司

总经理职务，公司董事长高峰先生不再代为履行公司总经理职务。

(2) 本报告期基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2017 年 9 月 1 日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今，本年度应支付的审计费用为 100,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
恒泰证券	2	170,516,785.24	24.79%	158,328.61	24.96%	-
华创证券	2	154,146,398.90	22.41%	143,557.04	22.63%	-
长江证券	1	144,215,953.45	20.96%	131,430.15	20.72%	-
平安证券	2	73,155,623.30	10.63%	68,129.71	10.74%	-
方正证券	1	57,737,035.01	8.39%	52,615.41	8.29%	-
东北证券	3	47,647,969.49	6.93%	43,418.35	6.84%	-
天风证券	2	36,613,971.08	5.32%	33,366.65	5.26%	-
广发证券	1	1,980,900.82	0.29%	1,844.73	0.29%	-
银河证券	1	1,090,068.82	0.16%	1,015.16	0.16%	-

国泰君安	1	573,393.40	0.08%	534.00	0.08%	-
中信证券	1	225,247.91	0.03%	205.25	0.03%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

安信证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：

- (1) 券商服务评价；
- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3、交易单元变更情况

本基金本报告期新增 1 个东北证券、1 个西藏东方财富、1 个华信证券、1 个瑞信方正证券、1 个东吴证券，终止 1 个中投证券交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
恒泰证券	19,955,112.93	74.76%	143,300,000.00	5.11%	-	-
华创证券	6,442,719.00	24.14%	62,000,000.00	2.21%	-	-

长江证券	295,332.30	1.11%	-	-	-	-
平安证券	-	-	1,450,000,000.00	51.75%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	6,000,000.00	0.21%	-	-
广发证券	-	-	80,500,000.00	2.87%	-	-
银河证券	-	-	867,000,000.00	30.94%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	193,000,000.00	6.89%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	01	20170101-20171231	1,259,251,515.15	0.00	249,020,000.00	1,010,231,515.15	99.99%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金单位份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求,本基金管理人经与基金托管人协商一致,对本基金合同进行了修订和更新。本次修订和更新仅涉及与《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》相关的条款,包括前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的投资、基金资产估值、基金的信息披露等,具体内容详见 2018 年 3 月 22 日基金管理人网站披露的相关公告和修订更新后的法律文件。

融通基金管理有限公司
二〇一八年三月二十九日